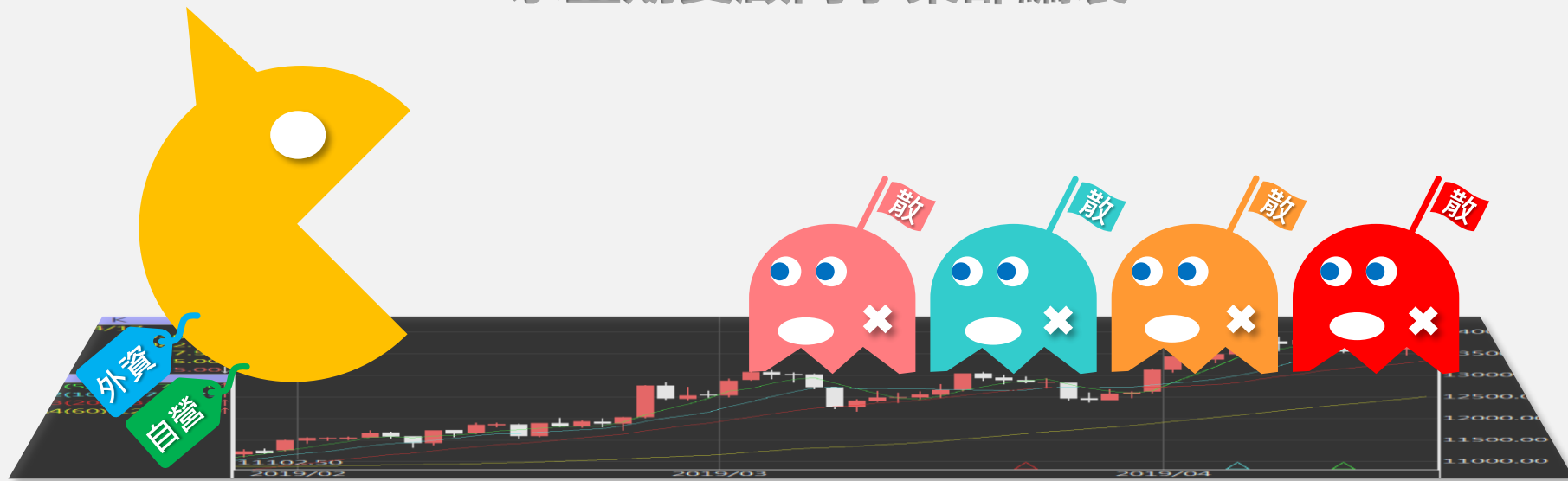


# 台指期盤後快訊

永豐期貨顧問事業部編製



# 收盤行情表

2024年10月11日 星期五

| 合約   | 收盤       | 漲跌      | 漲跌幅    | 成交量        | OI    | OI增減  |
|------|----------|---------|--------|------------|-------|-------|
| 加權指數 | 22901.64 | +242.56 | +1.06% | 3601.05 億元 |       |       |
| 台指10 | 22911    | +212    | +0.93% | 120944     | 77427 | -919  |
| 台指11 | 22959    | +224    | +0.99% | 8739       | 10121 | +5494 |
| 小台10 | 22911    | +212    | +0.93% | 247261     | 42838 | +2626 |
| 小台11 | 22959    | +224    | +0.99% | 15415      | 8021  | +414  |
| 微台10 | 22911    | +212    | +0.93% | 124539     | 21482 | -314  |
| 微台11 | 22959    | +224    | +0.99% | 9795       | 7217  | +1441 |
| 電子10 | 1247.85  | +16.25  | +1.32% | 807        | 1025  | -56   |
| 金融10 | 2073.8   | +4.80   | +0.23% | 371        | 1186  | -24   |
| 非金10 | 15331    | -13.00  | -0.08% | 112        | 93    | -18   |

# 雙十過後權值股有所表現 激勵指數開高走高

指數週五上漲242.56點，收在22901.64點，成交量3601.05億元。台指期上漲212點至22911點，正價差為9.36點。籌碼面部分，三大法人買超221.35億元；而在台指期淨部位方面，三大法人淨空單增加1432口至-16980口，其中外資淨空單增加1399口至-41849口；十大交易人中的特定法人全月份台指期淨空單增加4172口至-22902口。

9月核心消費者價格月增0.31%，高於預期的0.2%，此為3月以來的最強勁表現，導致核心CPI年增率上漲3.26%，高於預期的3.2%，不過權重最高的房租項目有所趨緩，整體CPI依然維持下降趨勢。2024年FOMC票委、亞特蘭大聯準銀行總裁波士蒂克(Raphael Bostic)表示，如果近期通膨和勞動力市場持續走強，他願意支持下月降息1碼，甚至可能支持「暫停降息」的決定。11月降息預期的收斂導致美十年債殖利率連續多日站上4%關卡，美債期貨表現疲弱。在近期公布的非農與通膨數據後，市場對於聯準會降息的預期明顯收斂，華爾街平均而言對於今年的總降息碼述回落至4碼。今日台股在雙十假期過後表現強勢，指數開高走高，不過下跌家數超過650家，盤面仍是權值股帶動為主，台積電上漲2.45%、聯發科大漲4.42%，目前指數維持震盪格局。

選擇權未平倉量部分，週買權最大OI落在23400點，週賣權最大OI落在20000點；月買權最大OI落在23900點，月賣權最大OI落在20700點。全月份未平倉量put/call ratio值由1.12上升至1.17。VIX指數下降0.74至24.33。外資台指期買權淨金額-0.15億元；賣權淨金額0.45億元。整體選擇權籌碼面偏多。(永豐期貨研調)

# 三大法人籌碼變化 單位：口 / 億元

|    | 現貨<br>(金額) | 台指<br>(口數)        | Call<br>(口數)     | Put<br>(口數)      | Call<br>(金額)     | Put<br>(金額)     |
|----|------------|-------------------|------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 外資 | +219.89    | -41849<br>(-1399) | 3951<br>(+3592)  | 2312<br>(-1041)  | -0.15<br>(+0.13) | 0.45<br>(+0.04) |
| 投信 | +23.94     | 25562<br>(+40)    | -400<br>(0)      | 0<br>(0)         | -0.04<br>(-0.01) | 0<br>(0)        |
| 自營 | -22.47     | -693<br>(-73)     | 5523<br>(+6784)  | -5463<br>(-3738) | 1.61<br>(+0.70)  | 1.48<br>(-0.28) |
| 合計 | +221.35    | -16980<br>(-1432) | 9074<br>(+10376) | -3151<br>(-4779) | 1.42<br>(+0.82)  | 1.93<br>(-0.24) |

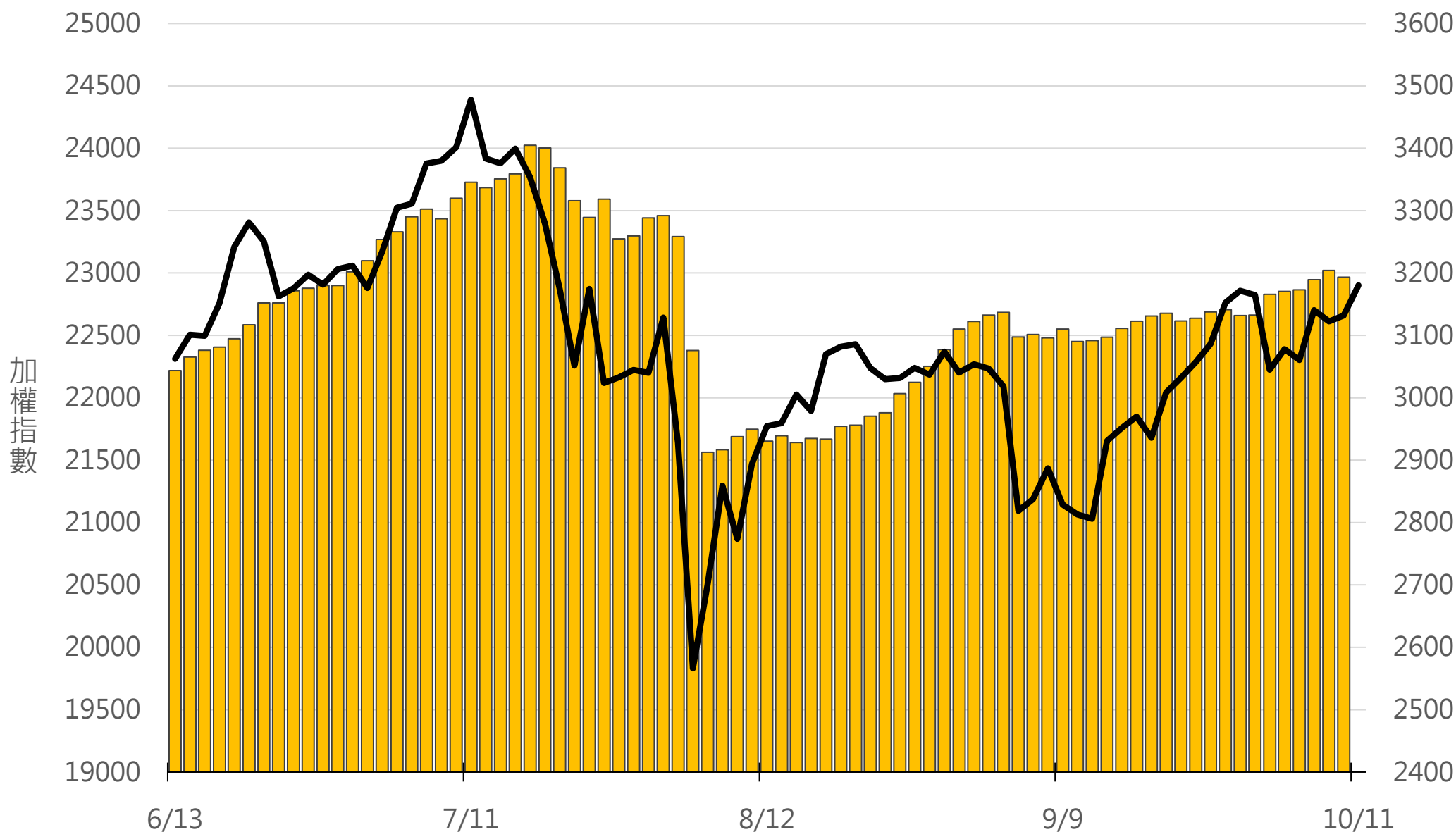
# 十大交易人期權淨部位(口)

|    | 十大(特定人)           |                  | 十大(非特定人)         |                  | 全市場OI              |
|----|-------------------|------------------|------------------|------------------|--------------------|
|    | 近月                | 其他月              | 近月               | 其他月              |                    |
| 台指 | -21441<br>(-1938) | -1461<br>(-2234) | 7847<br>(+473)   | 42<br>(+1957)    | 100087<br>(+5545)  |
| 買權 | 4950<br>(+357)    | 2136<br>(+1581)  | -1053<br>(+3352) | -1992<br>(-1900) | 131060<br>(+26030) |
| 賣權 | -1176<br>(+717)   | -4126<br>(-1308) | 4374<br>(-2732)  | -2319<br>(+2679) | 153733<br>(+36095) |

# 上市融資餘額(億元)

圖表僅更新至前一日數據

# 3193.2



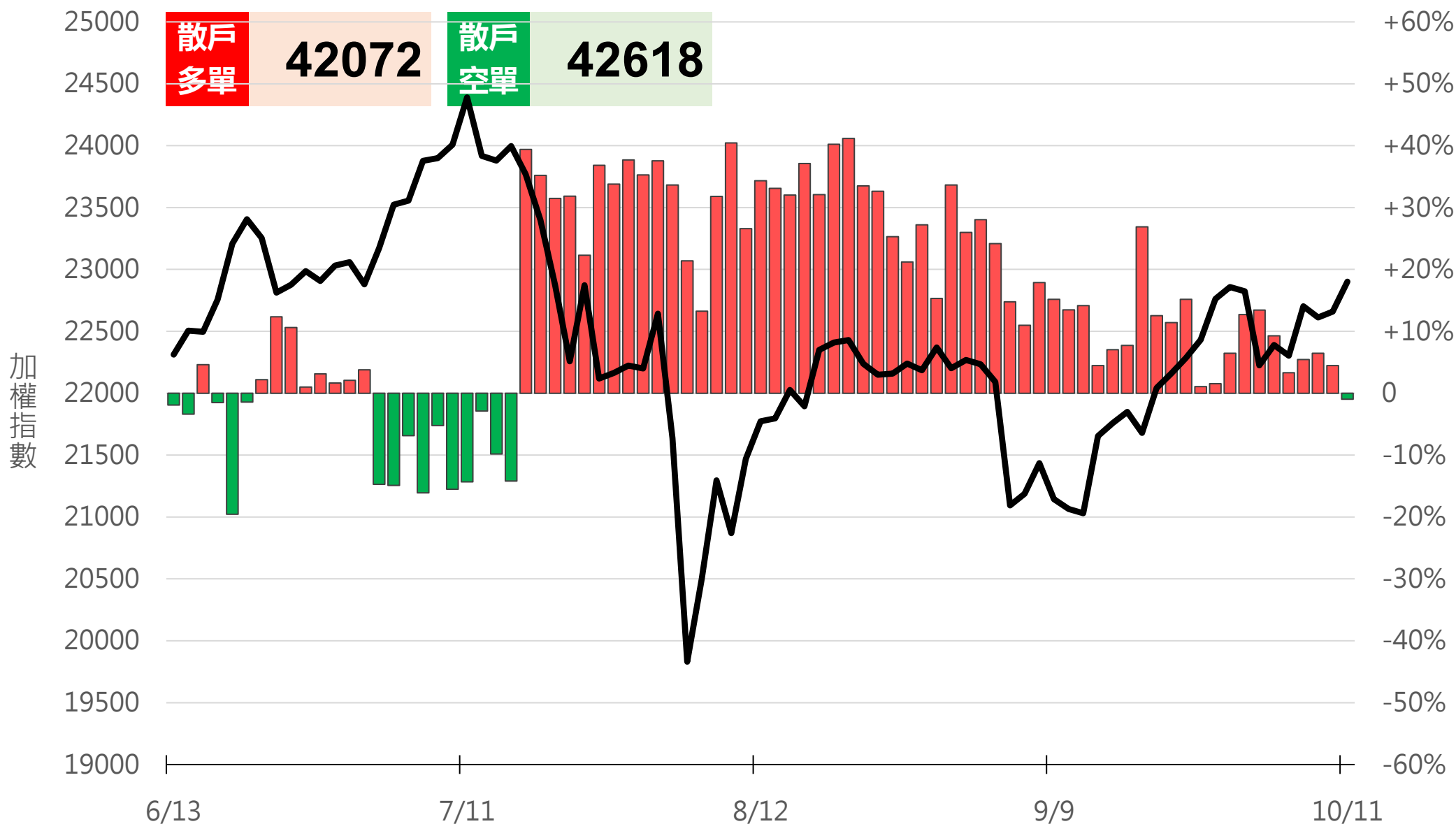
# 小台散戶多空比

散戶多單=全市場OI-三大法人多單

散戶空單=全市場OI-三大法人空單

散戶多空比=(散戶多單-散戶空單)/全市場OI x 100%

## -0.97%



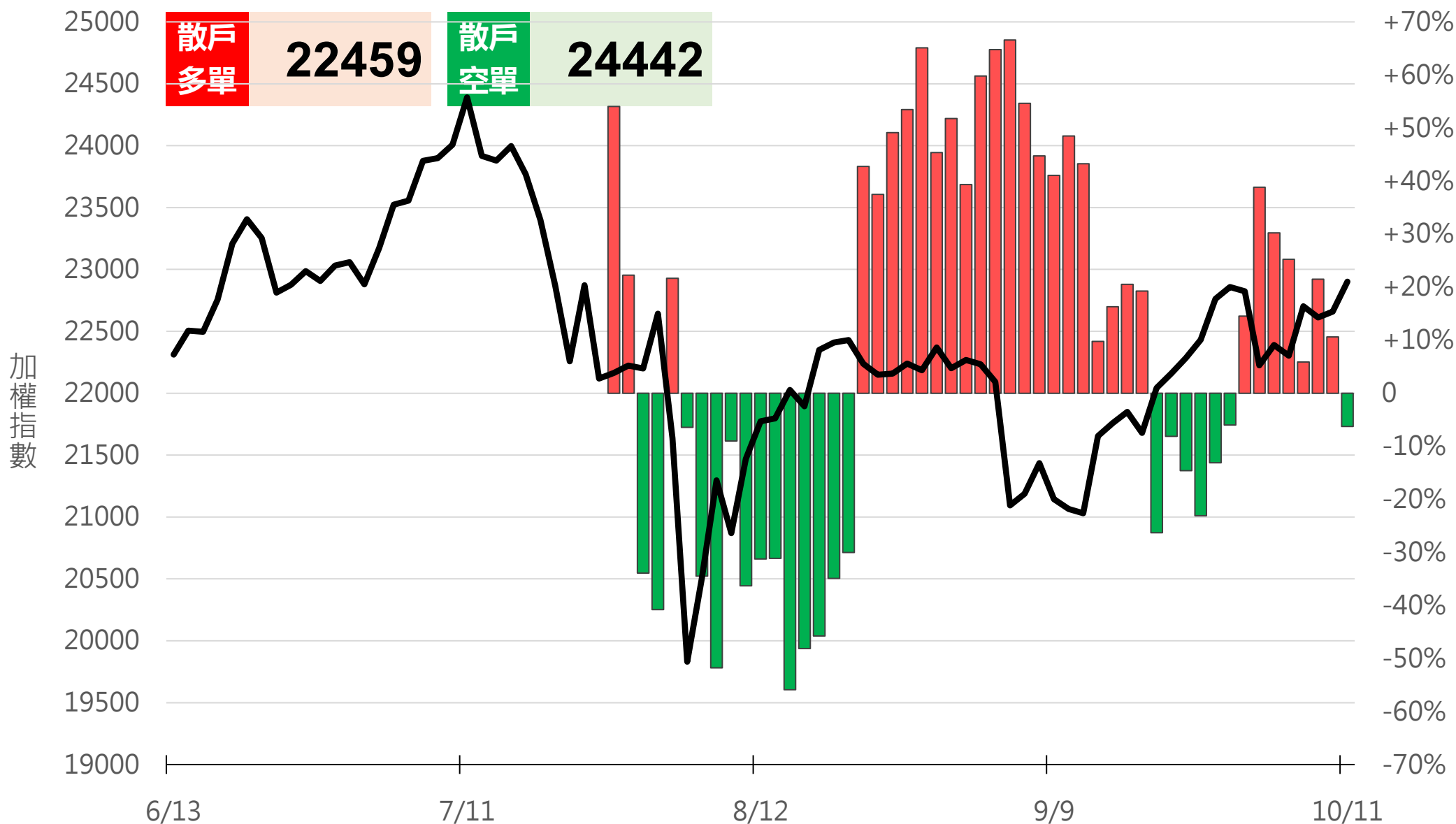
# 微台股散戶多空比

散戶多單=全市場OI-三大法人多單

散戶空單=全市場OI-三大法人空單

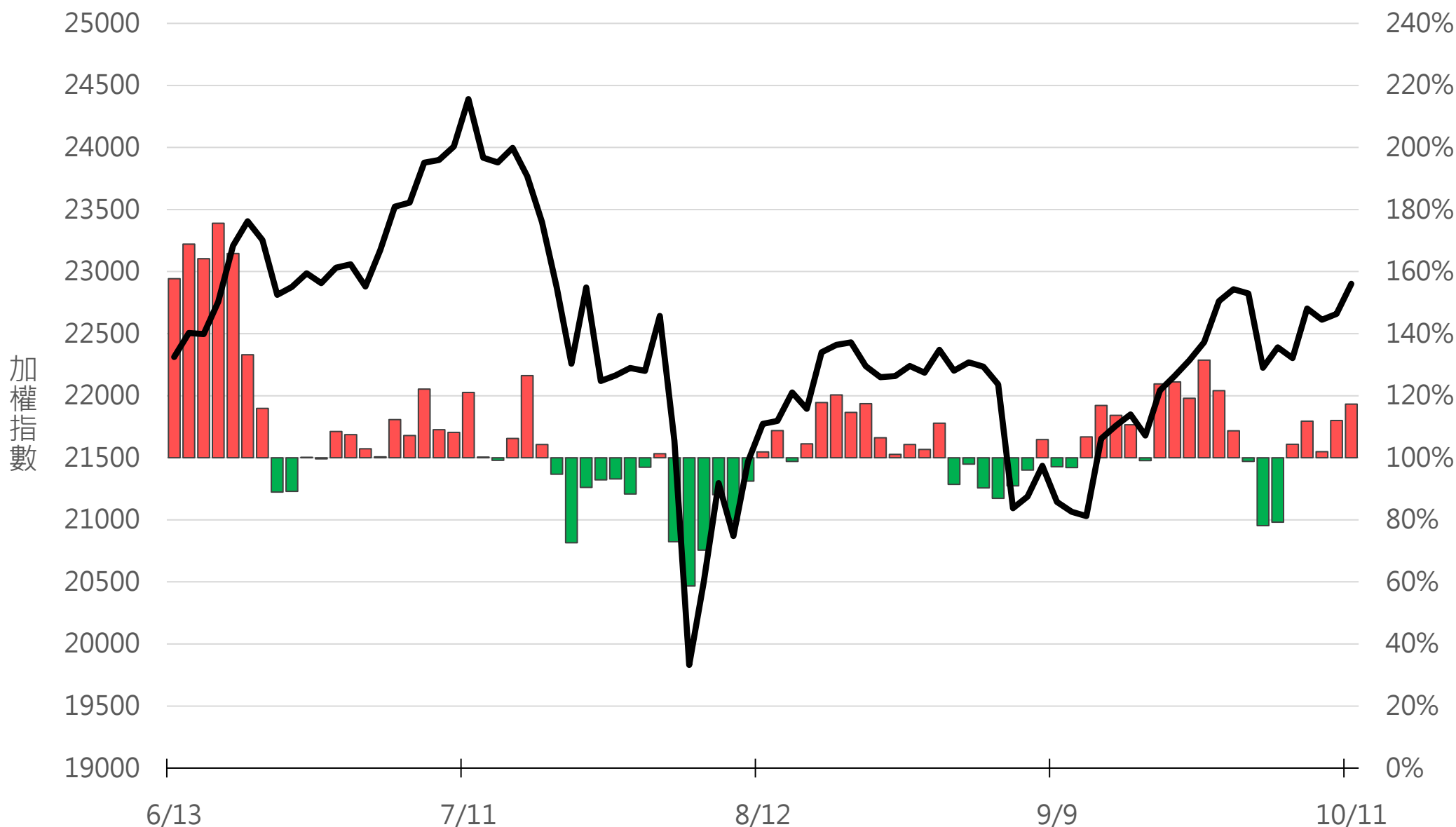
散戶多空比=(散戶多單-散戶空單)/全市場OI x 100%

## -6.27%



# Put/Call Ratio

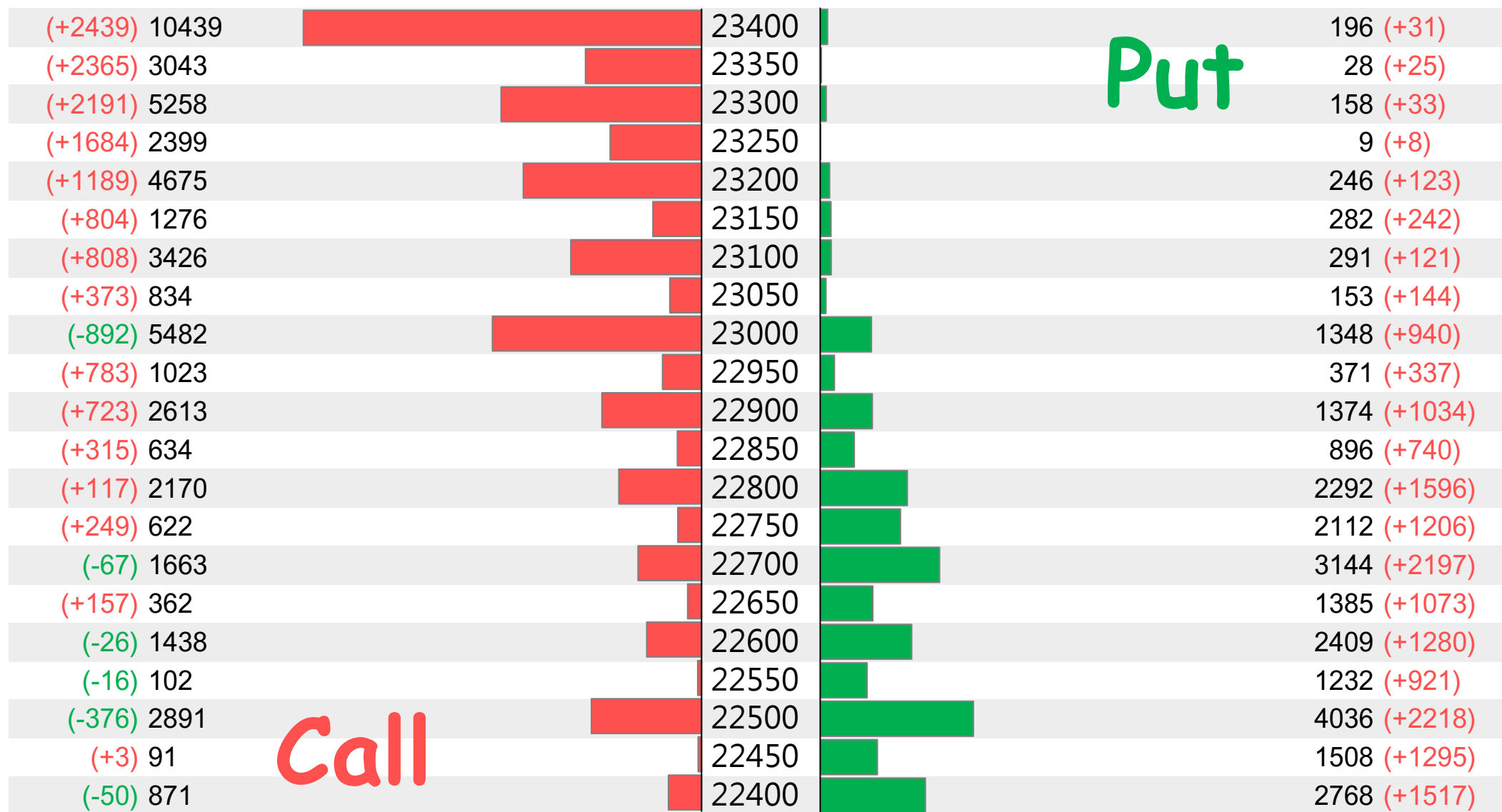
# 117.30%



# 10月大量區

## 買權 23400

## 賣權 20000



# 10月W4大量區

買權 23900

賣權 20700

|           |  |       |  |     |        |
|-----------|--|-------|--|-----|--------|
| (+79) 100 |  | 23500 |  | 0   | -      |
| (+42) 50  |  | 23400 |  | 0   | -      |
| (+85) 106 |  | 23300 |  | 15  | (+15)  |
| (+59) 60  |  | 23250 |  | 37  | (+37)  |
| (+80) 102 |  | 23200 |  | 22  | (+22)  |
| (+64) 84  |  | 23150 |  | 23  | (+23)  |
| (+63) 119 |  | 23100 |  | 32  | (+32)  |
| (+33) 53  |  | 23050 |  | 18  | (+18)  |
| (+52) 95  |  | 23000 |  | 64  | (+47)  |
| (+61) 63  |  | 22950 |  | 31  | (+28)  |
| (+42) 72  |  | 22900 |  | 55  | (+53)  |
| (+24) 26  |  | 22850 |  | 26  | (+26)  |
| (+6) 17   |  | 22800 |  | 112 | (+107) |
| (-16) 5   |  | 22750 |  | 15  | (+14)  |
| (+14) 39  |  | 22700 |  | 63  | (+60)  |
| (+3) 24   |  | 22650 |  | 81  | (+44)  |
| (+24) 25  |  | 22600 |  | 123 | (+71)  |
| - 20      |  | 22550 |  | 13  | (+11)  |
| (+7) 9    |  | 22500 |  | 28  | (+25)  |
| - 0       |  | 22450 |  | 26  | (+5)   |
| (+2) 2    |  | 22400 |  | 287 | (+265) |

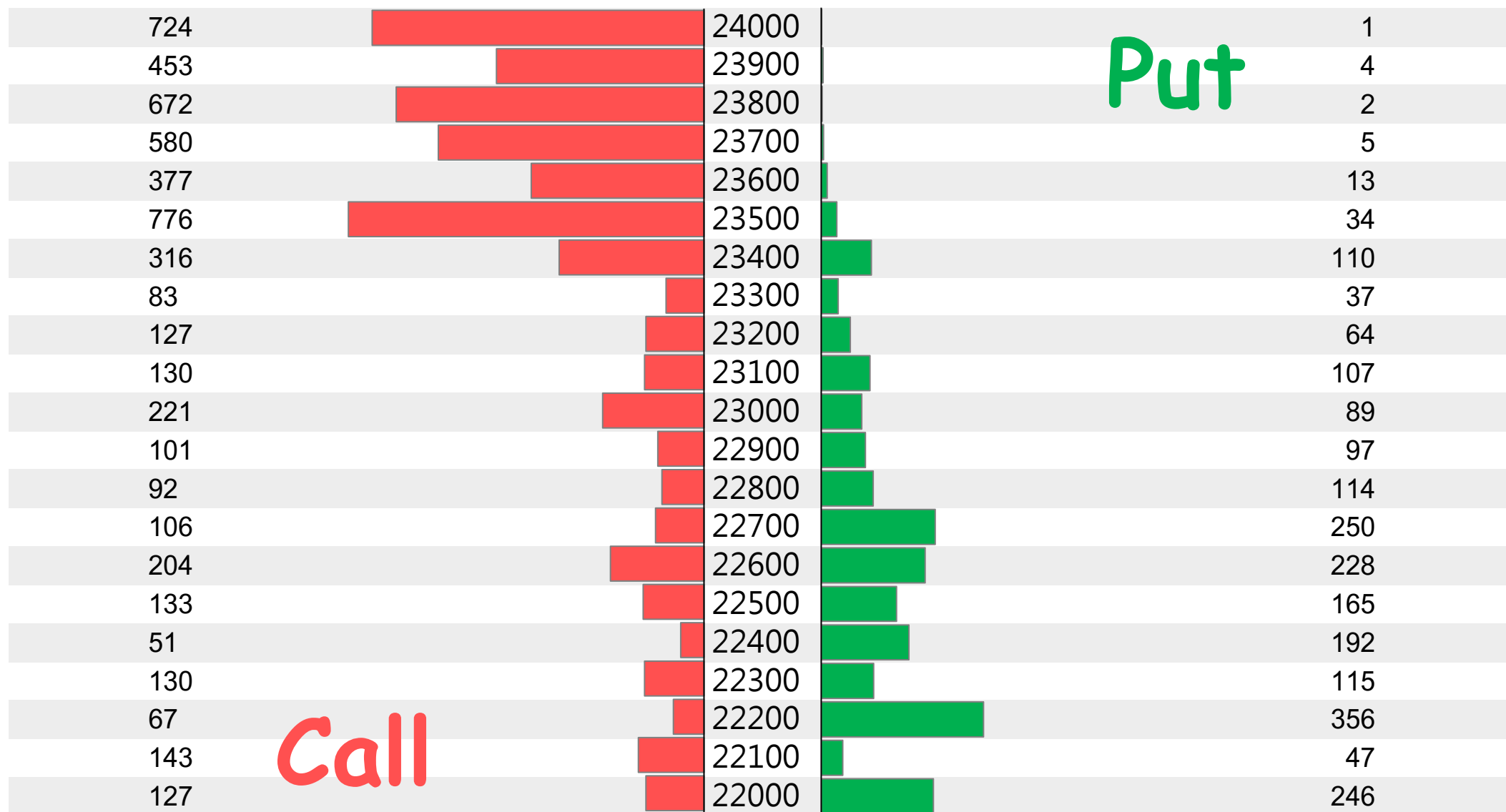
Put

Call

# 11月大量區

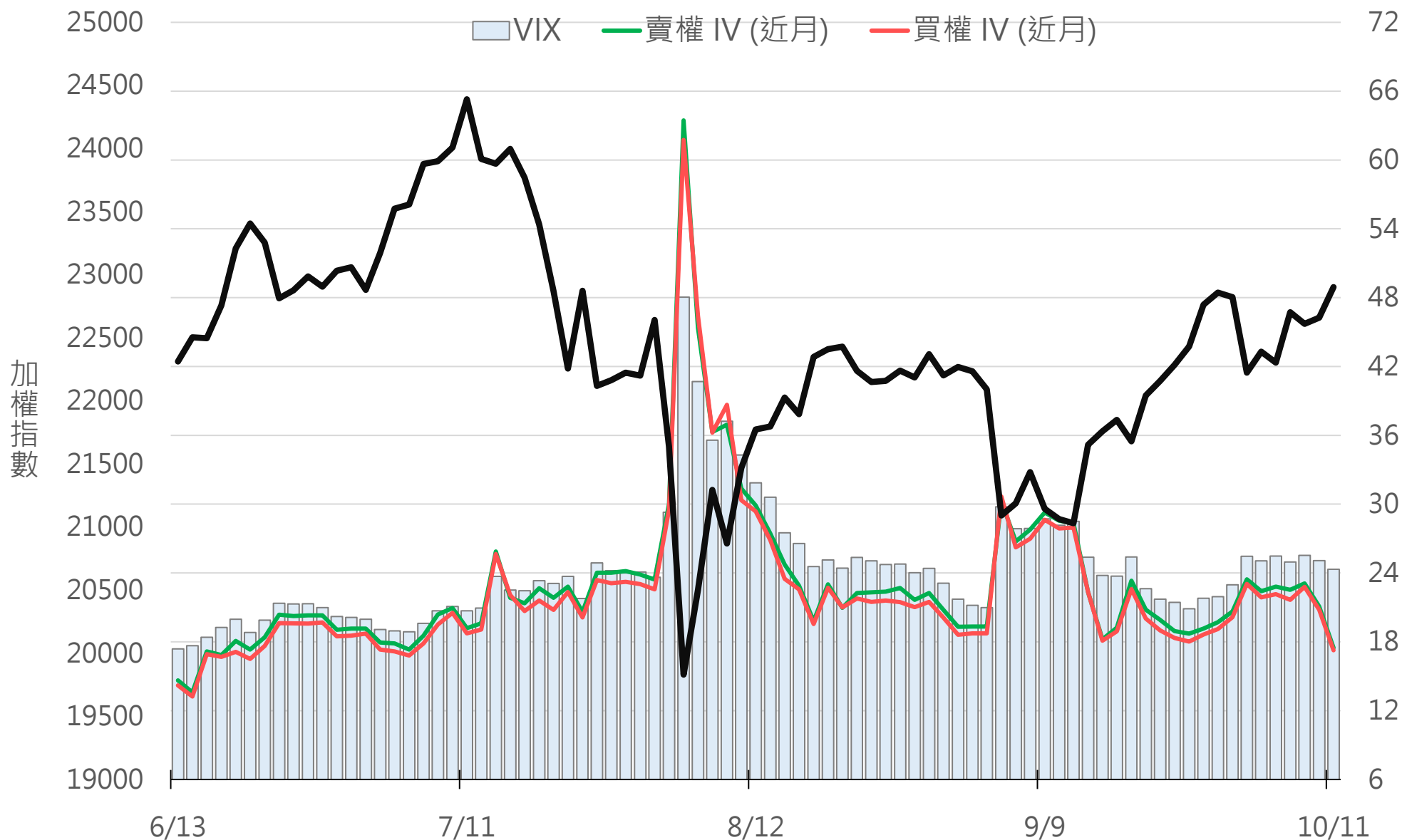
買權 25000

賣權 20900



# 台指選波動度

VIX ▼ 24.33 買權 IV ▼ 17.27  
賣權 IV ▼ 17.49



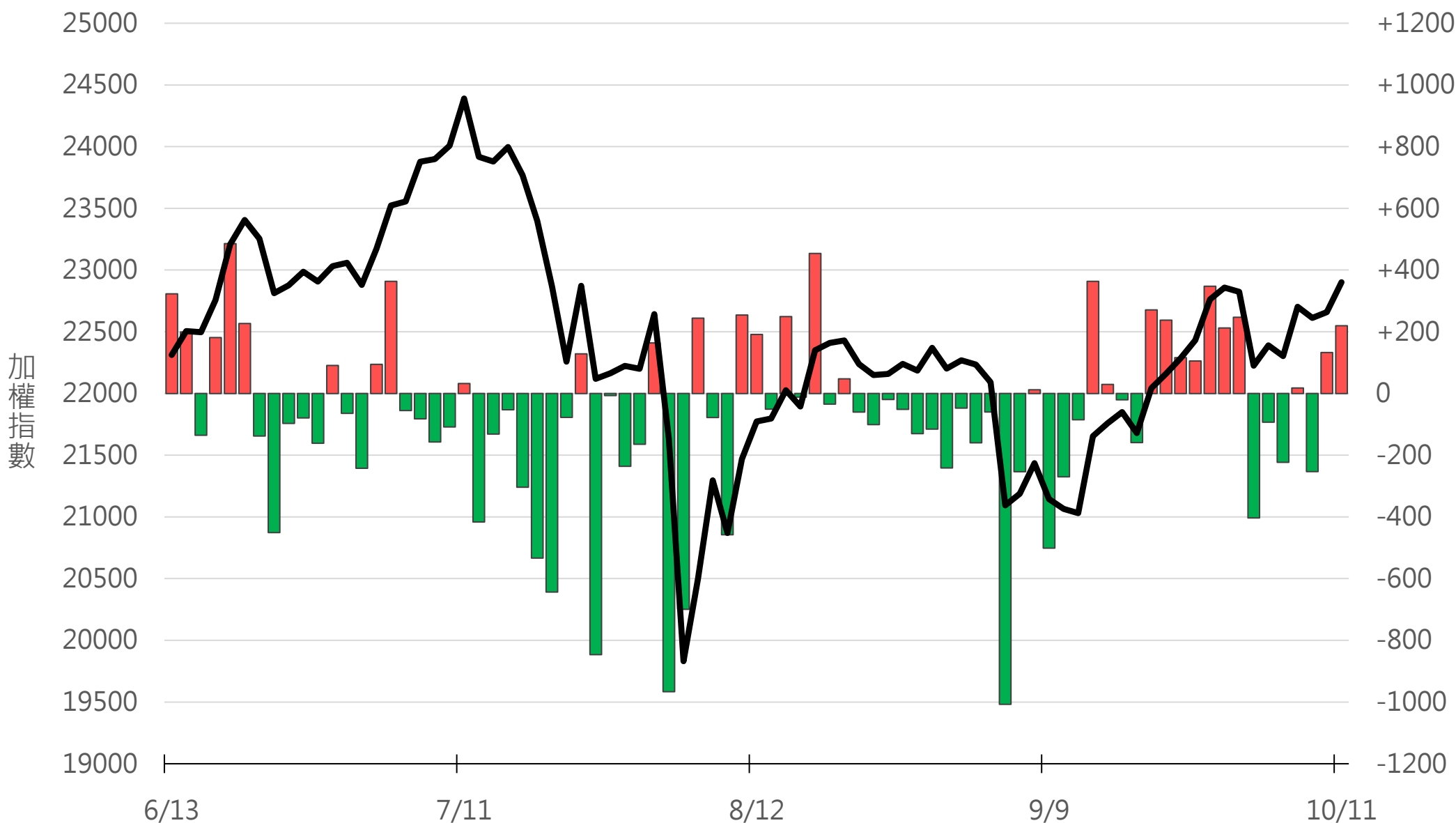
永豐期貨  
SinoPac Futures

永豐期貨股份有限公司 | 台北市重慶南路一段2號8樓 | 02-2381-1799 | 111年金管期總字第007號 | 顧問事業部  
本研究報告純屬研究性質僅供參考，不保證其完整性及精確性，報告內容具時效性，邇後若有變更，本公司將不做預告或主動更新。交易人決策時應衡量自身需求與交易風險，並就交易結果自行負責，本公司恕不負任何法律責任，亦不作任何保證。未經授權，禁止任何形式抄襲、引用或轉載。

2024/10/11

# 外資買賣超(億元)

## +219.89



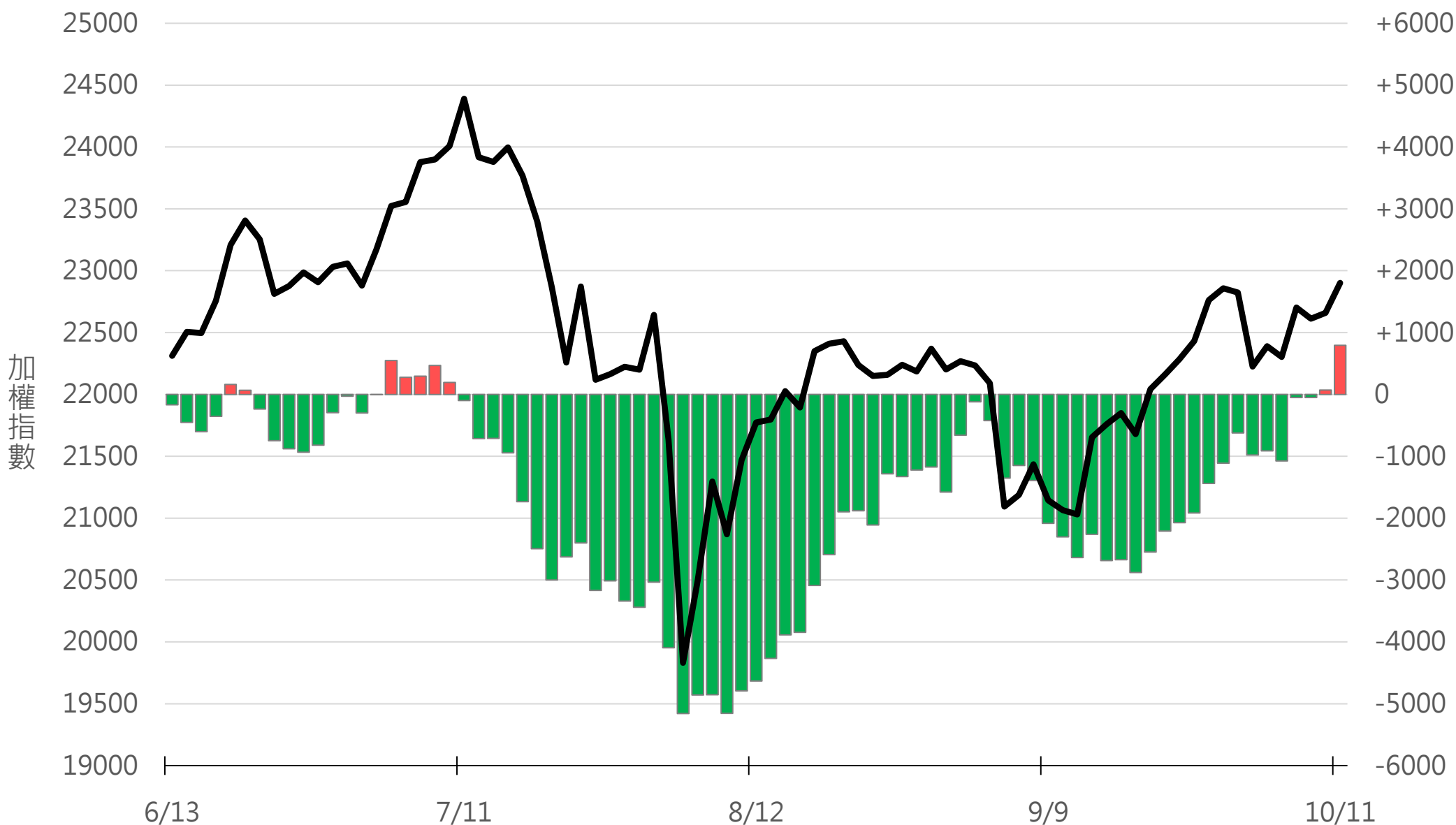
永豐期貨  
SinoPac Futures

永豐期貨股份有限公司 | 台北市重慶南路一段2號8樓 | 02-2381-1799 | 111年金管期總字第007號 | 顧問事業部  
本研究報告純屬研究性質僅供參考，不保證其完整性及精確性，報告內容具時效性，邇後若有變更，本公司將不做預告或主動更新。交易人決策時應衡量自身需求與交易風險，並就交易結果自行負責，本公司恕不負任何法律責任，亦不作任何保證。未經授權，禁止任何形式抄襲、引用或轉載。

2024/10/11

# 外資近20日累計買賣超(億元)

## +792.30



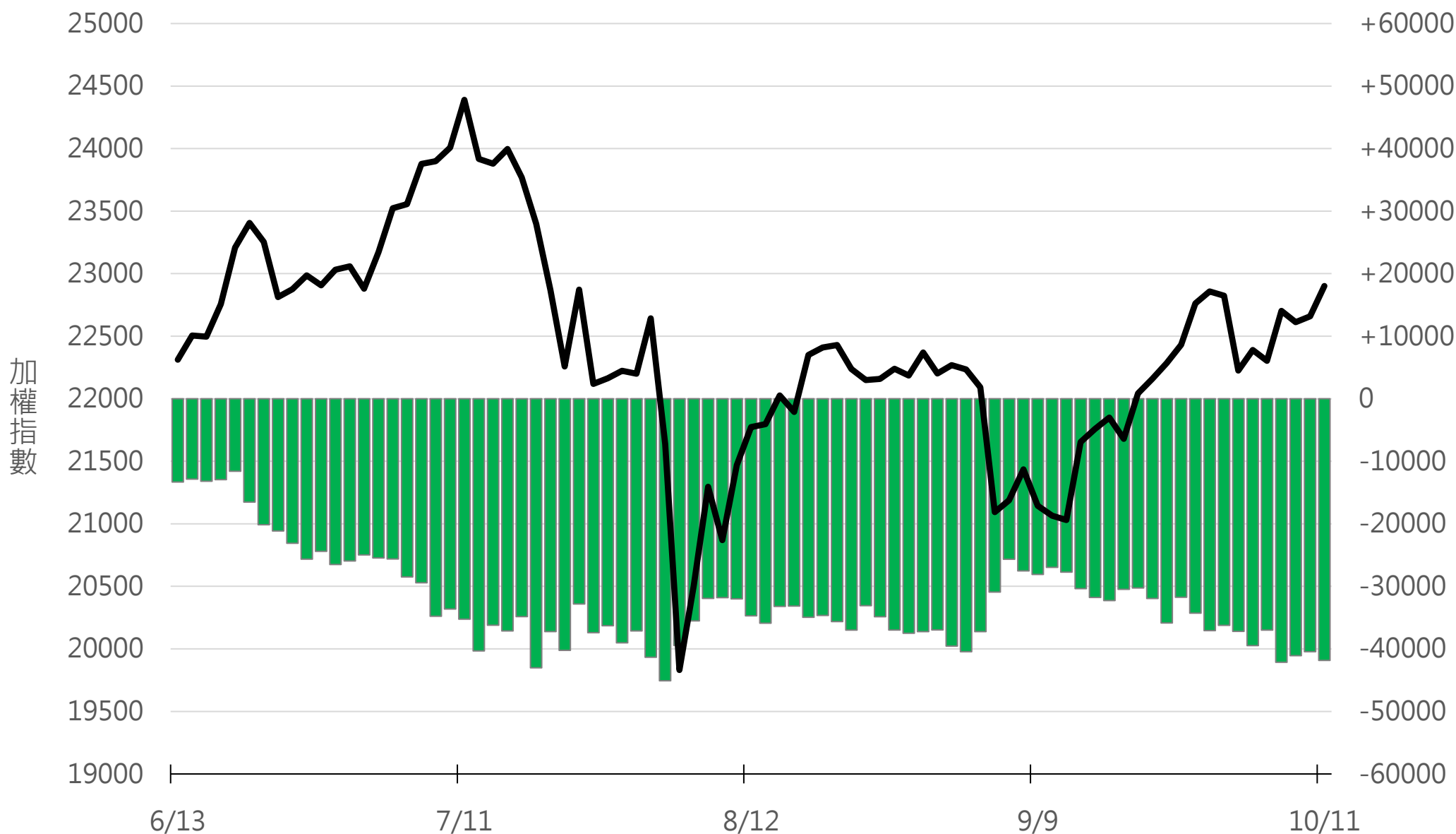
永豐期貨  
SinoPac Futures

永豐期貨股份有限公司 | 台北市重慶南路一段2號8樓 | 02-2381-1799 | 111年金管期總字第007號 | 顧問事業部  
本研究報告純屬研究性質僅供參考，不保證其完整性及精確性，報告內容具時效性，邇後若有變更，本公司將不做預告或主動更新。交易者決策時應衡量自身需求與交易風險，並就交易結果自行負責，本公司恕不負任何法律責任，亦不作任何保證。未經授權，禁止任何形式抄襲、引用或轉載。

2024/10/11

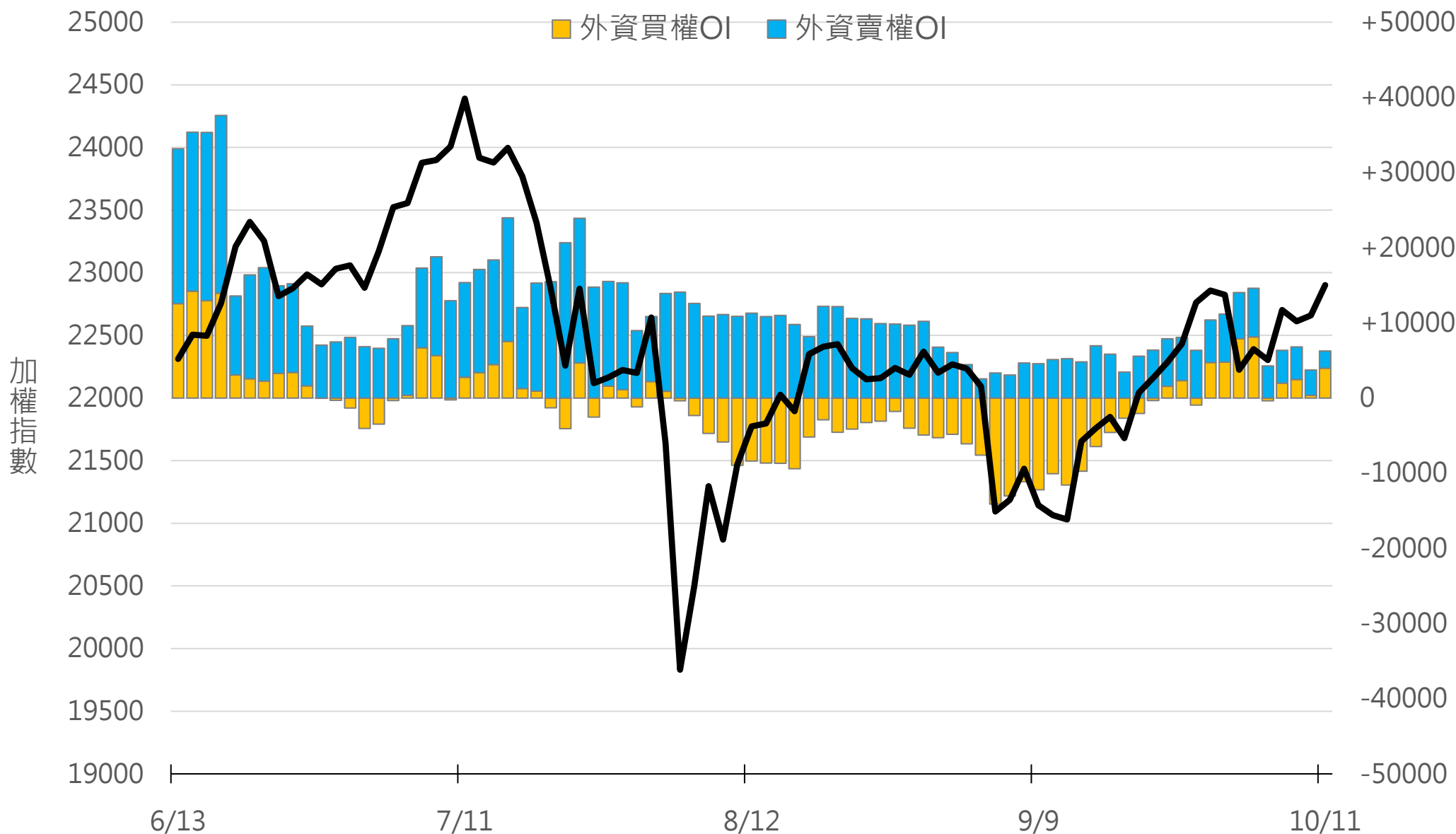
# 外資台指期O(口)

# -41849



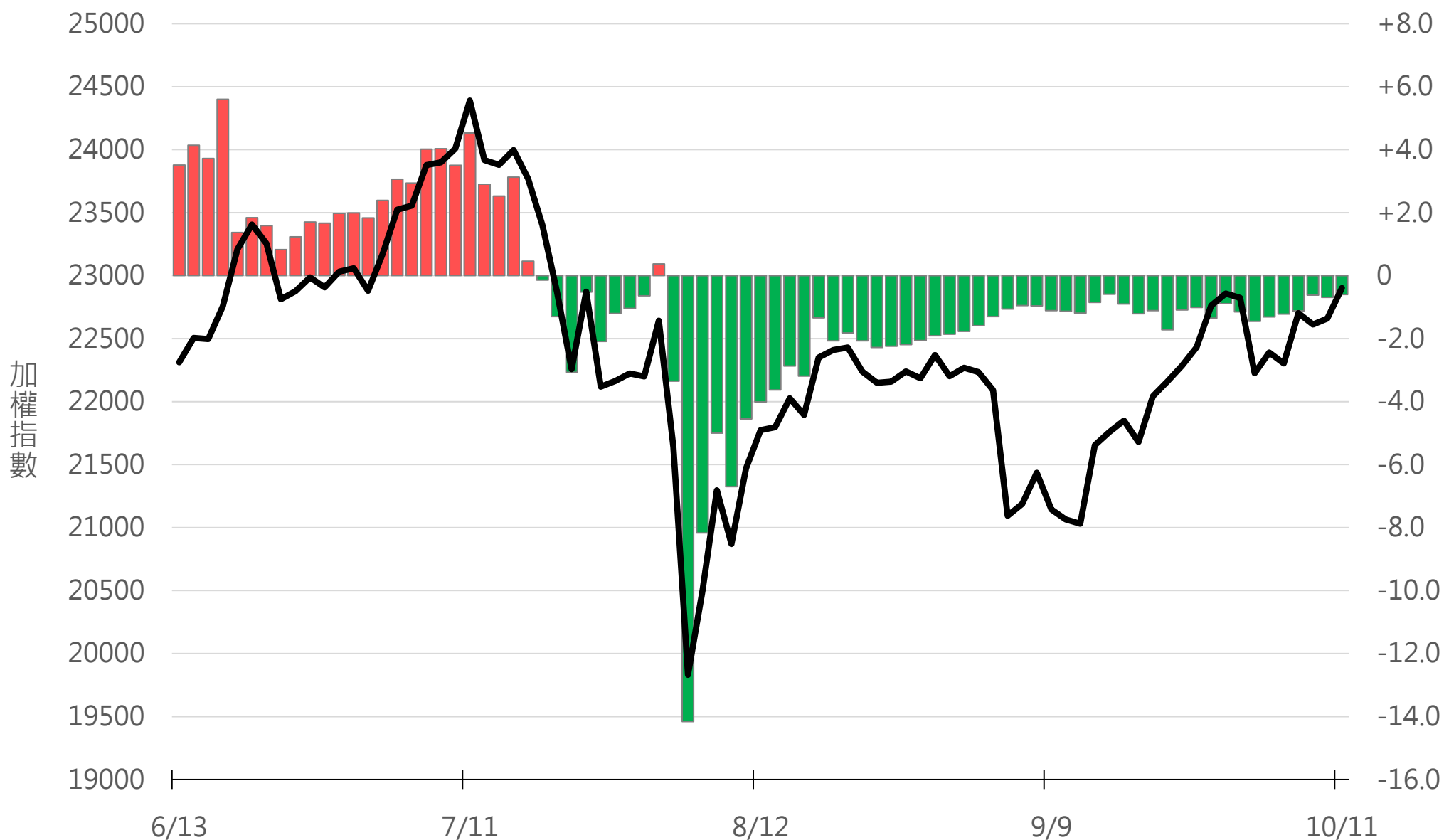
# 外資選權OI(口) 0軸以上為買方，以下為賣方

買權 +3951  
賣權 +2312



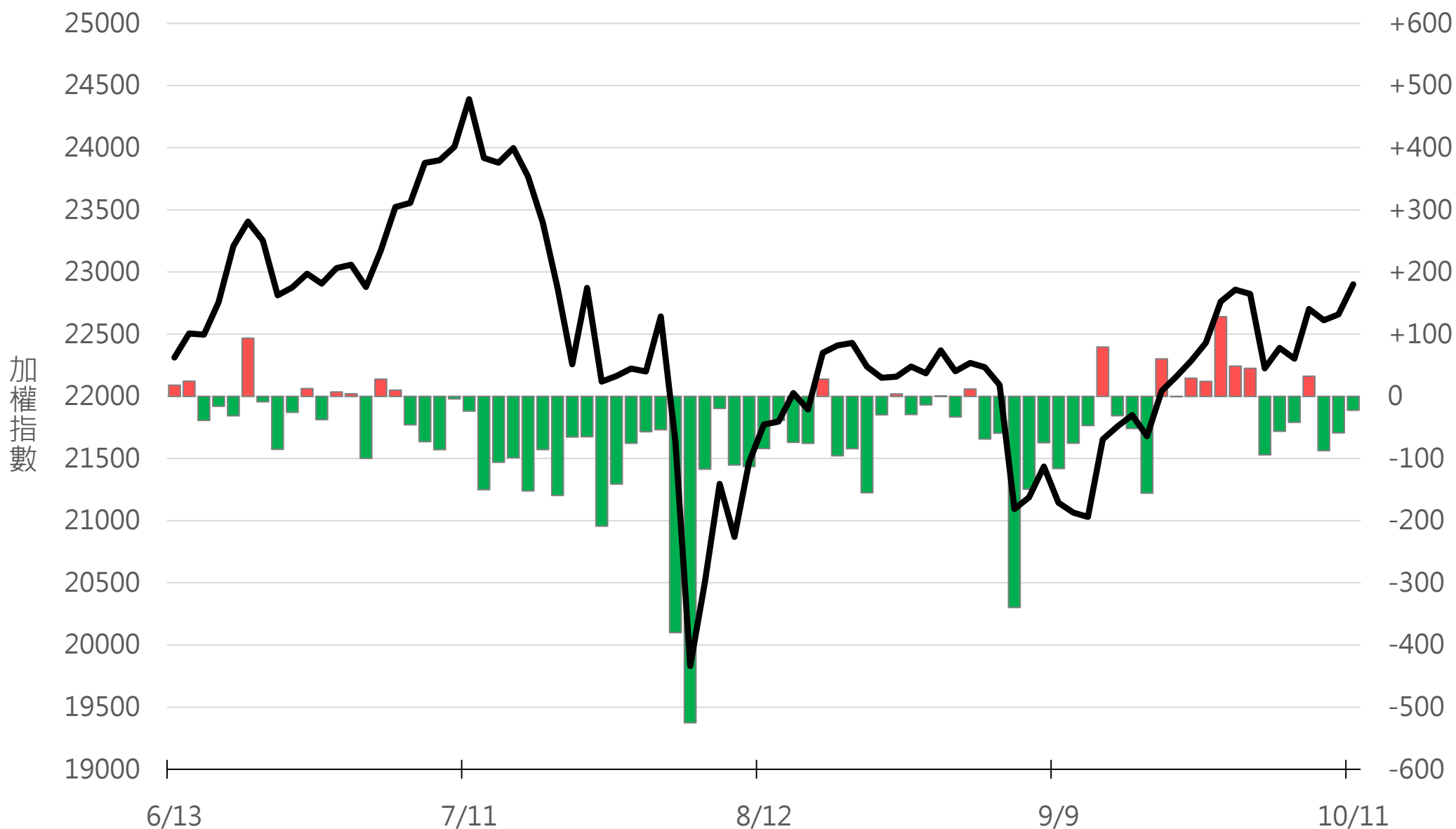
# 外資選權OI淨金額(億元)

-0.60



# 自營買賣超(億元)

# -22.47



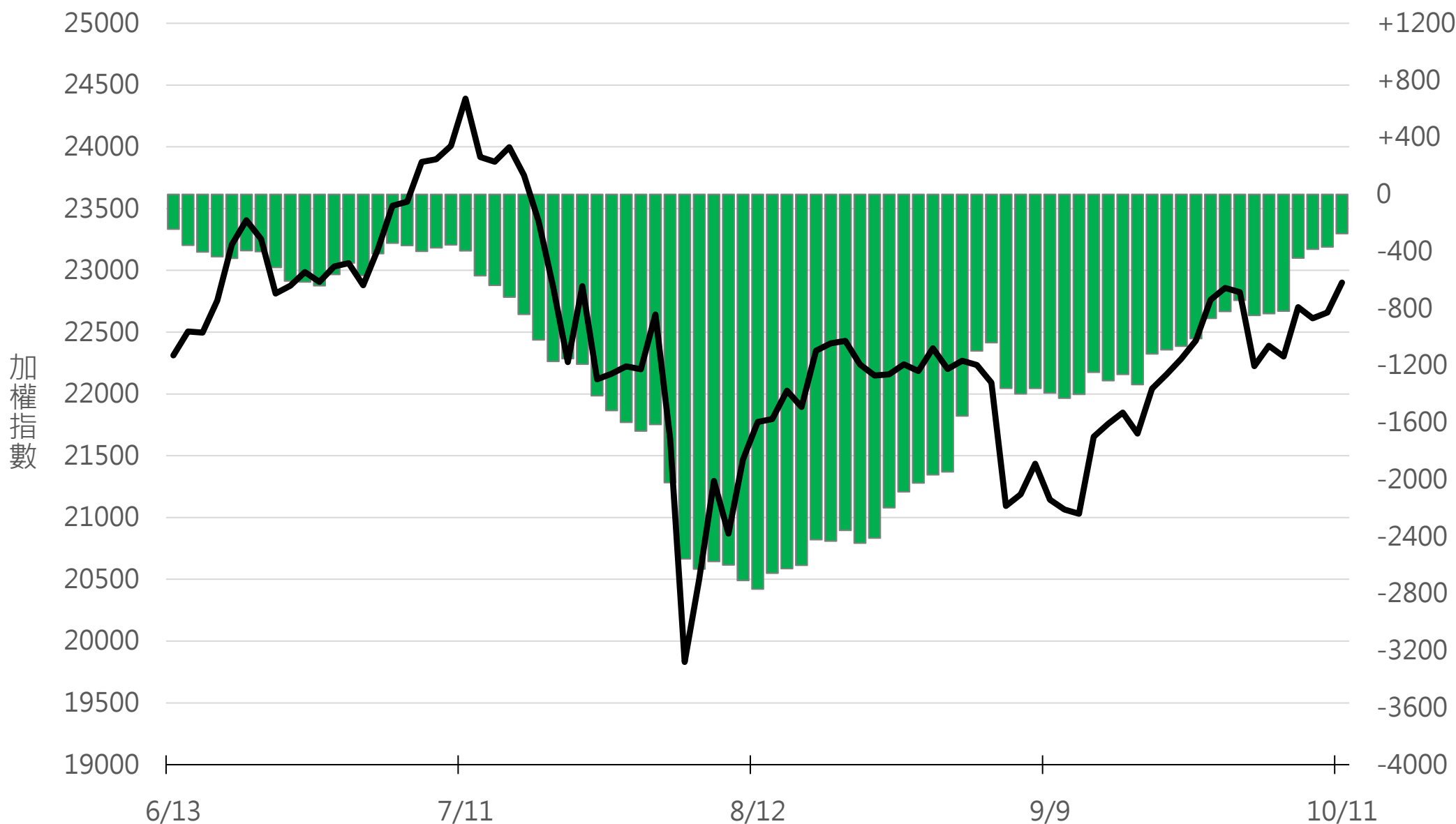
永豐期貨  
SinoPac Futures

永豐期貨股份有限公司 | 台北市重慶南路一段2號8樓 | 02-2381-1799 | 111年金管期總字第007號 | 顧問事業部  
本研究報告純屬研究性質僅供參考，不保證其完整性及精確性，報告內容具時效性，邇後若有變更，本公司將不做預告或主動更新。交易人決策時應衡量自身需求與交易風險，並就交易結果自行負責，本公司恕不負任何法律責任，亦不作任何保證。未經授權，禁止任何形式抄襲、引用或轉載。

2024/10/11

# 自營近20日累計買賣超(億元)

## -275.75



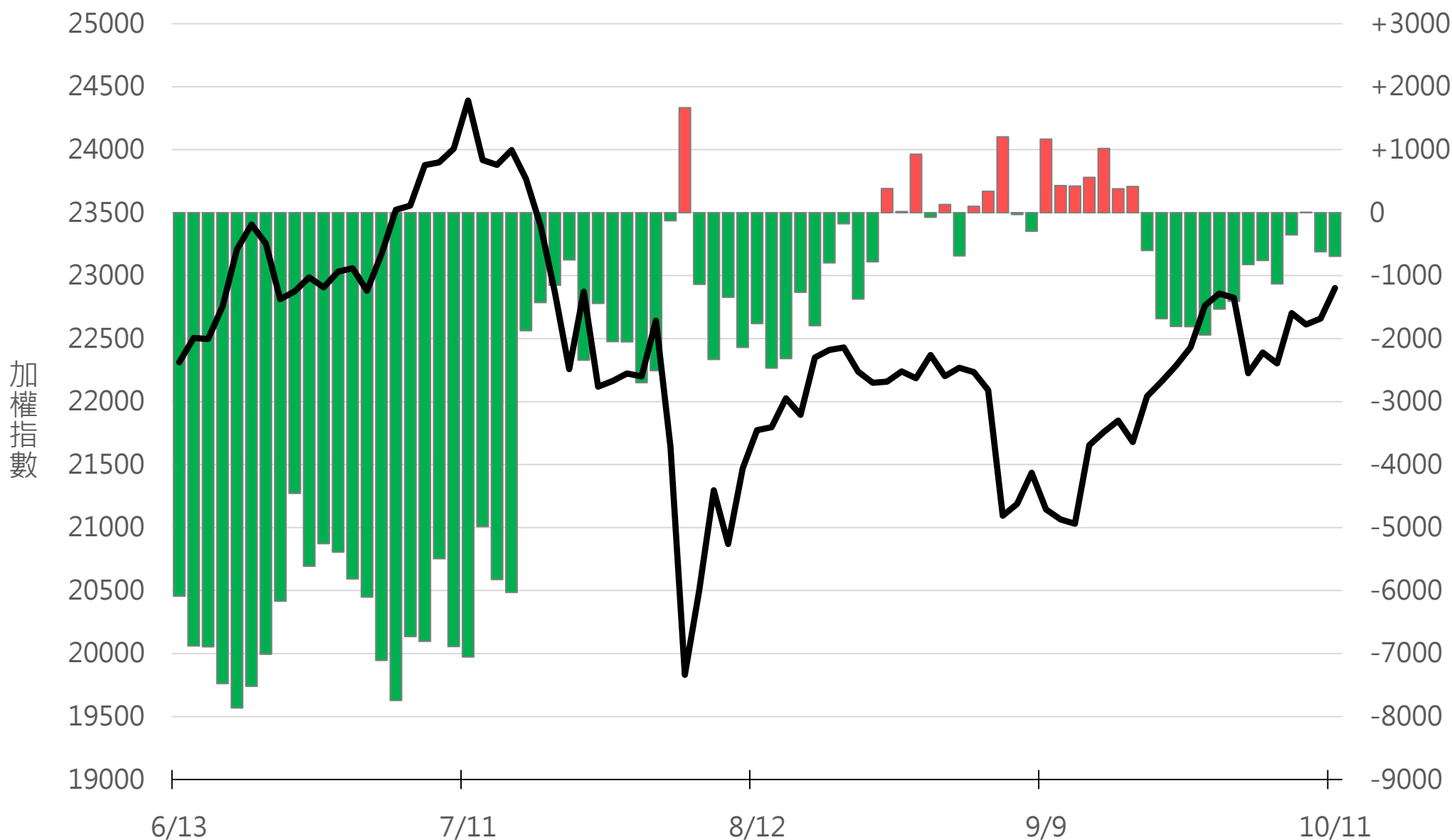
永豐期貨  
SinoPac Futures

永豐期貨股份有限公司 | 台北市重慶南路一段2號8樓 | 02-2381-1799 | 111年金管期總字第007號 | 顧問事業部  
本研究報告純屬研究性質僅供參考，不保證其完整性及精確性，報告內容具時效性，邇後若有變更，本公司將不做預告或主動更新。交易人決策時應衡量自身需求與交易風險，並就交易結果自行負責，本公司恕不負任何法律責任，亦不作任何保證。未經授權，禁止任何形式抄襲、引用或轉載。

2024/10/11

# 自營台指期O(口)

-693



永豐期貨  
SinoPac Futures

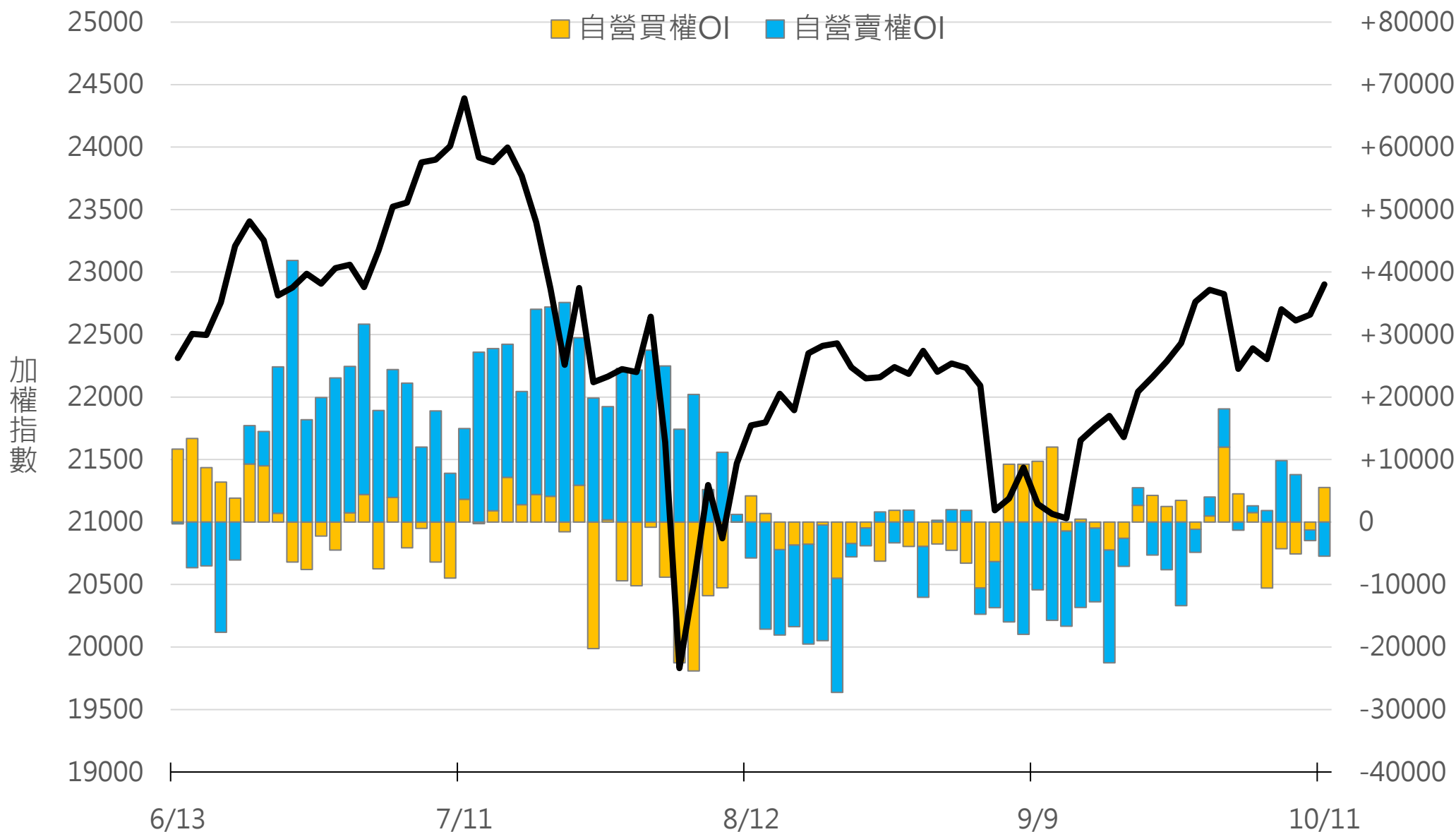
永豐期貨股份有限公司 | 台北市重慶南路一段2號8樓 | 02-2381-1799 | 111年金管期總字第007號 | 顧問事業部  
本研究報告純屬研究性質僅供參考，不保證其完整性及精確性，報告內容具時效性，遷後若有變更，本公司將不做預告或主動更新。交易人決策時應衡量自身需求與交易風險，並就交易結果自行負責，本公司恕不負任何法律責任，亦不作任何保證。未經授權，禁止任何形式抄襲、引用或轉載。

2024/10/11

# 自營選權OI(口) 0軸以上為買方，以下為賣方

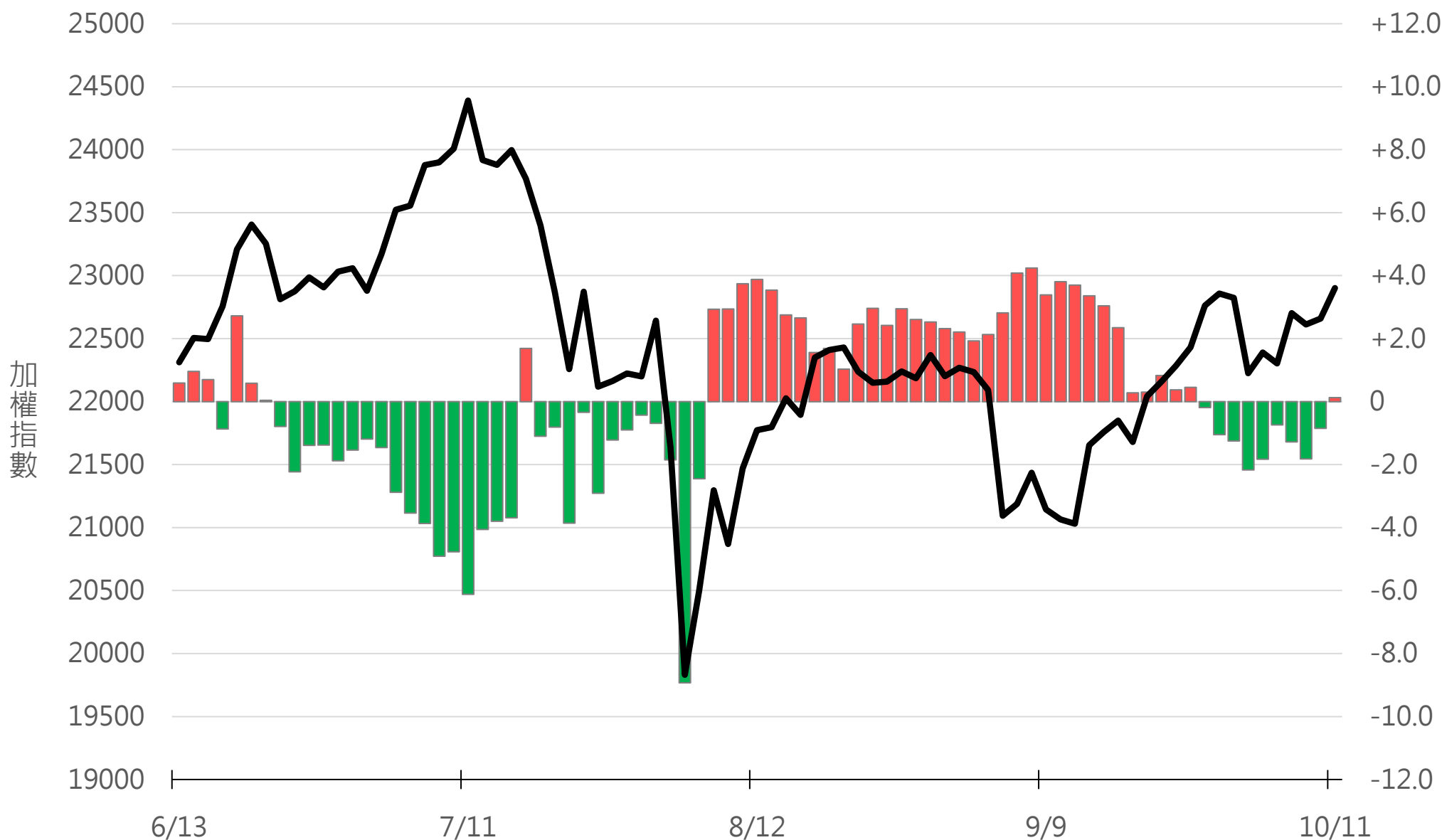
買權  
賣權

+5523  
-5463



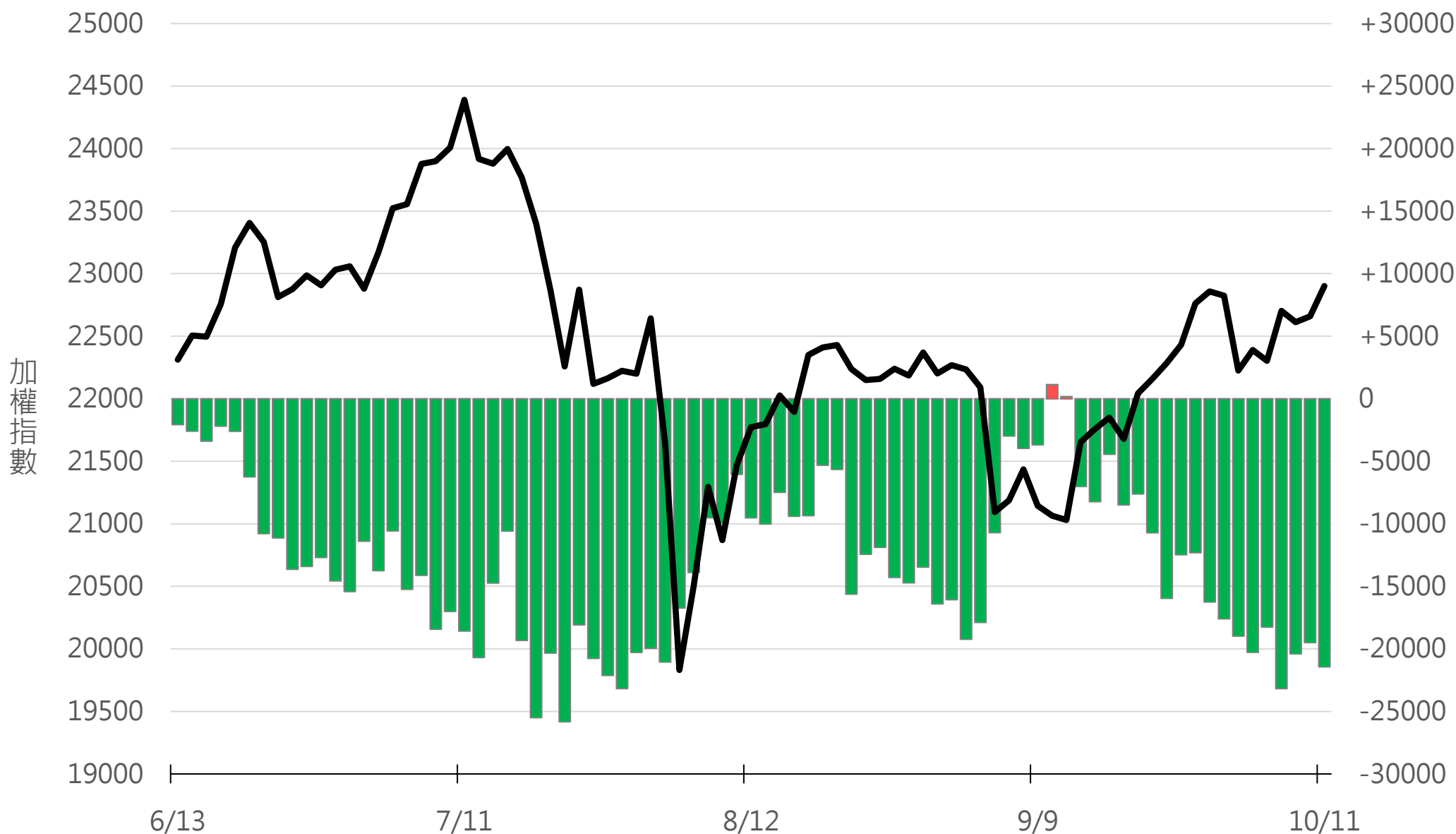
# 自營選權OI淨金額(億元)

+0.13



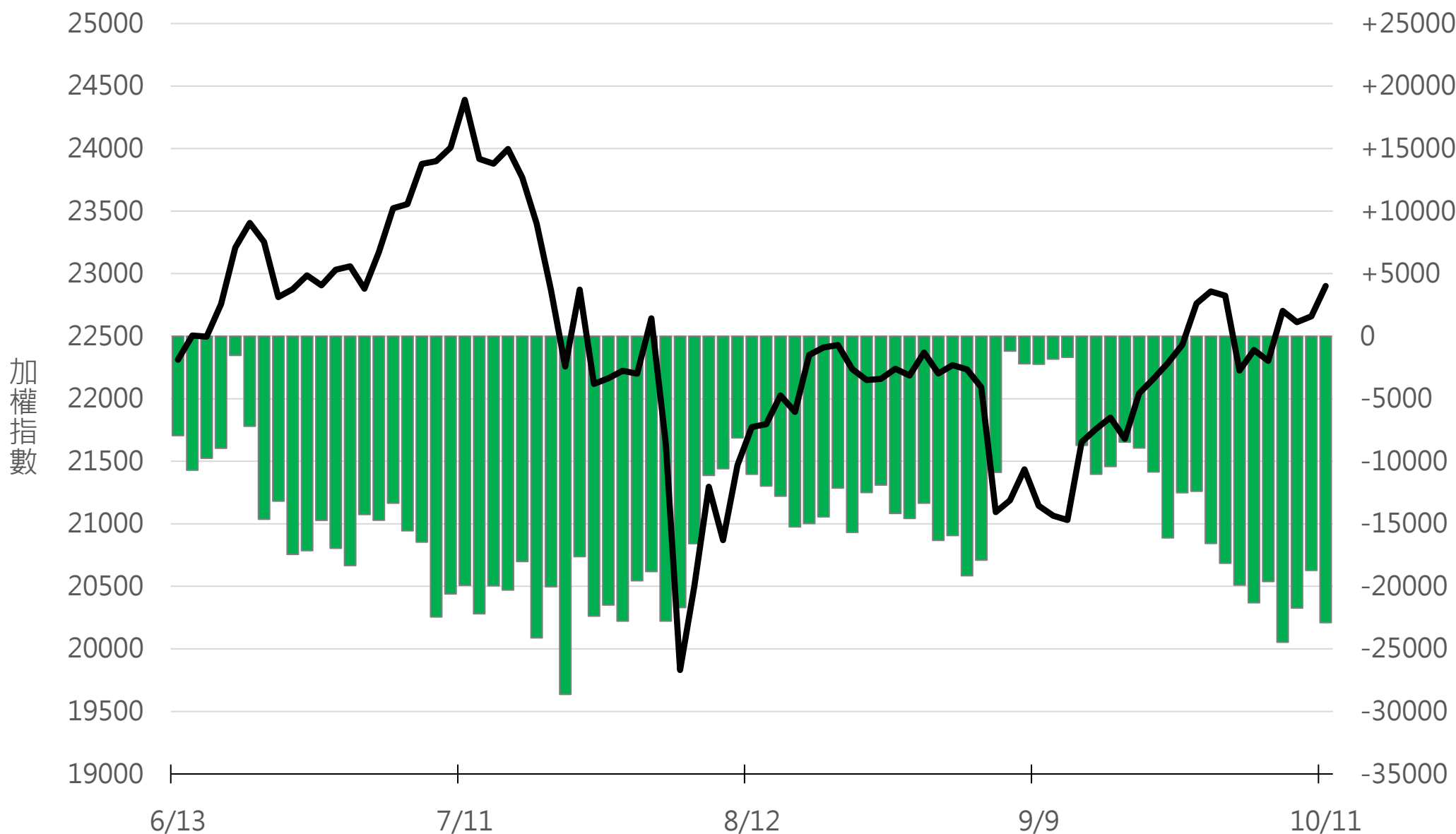
# 十特近月台指期OI(口)

-21441



# 十特全月台指期OI(口)

## -22902

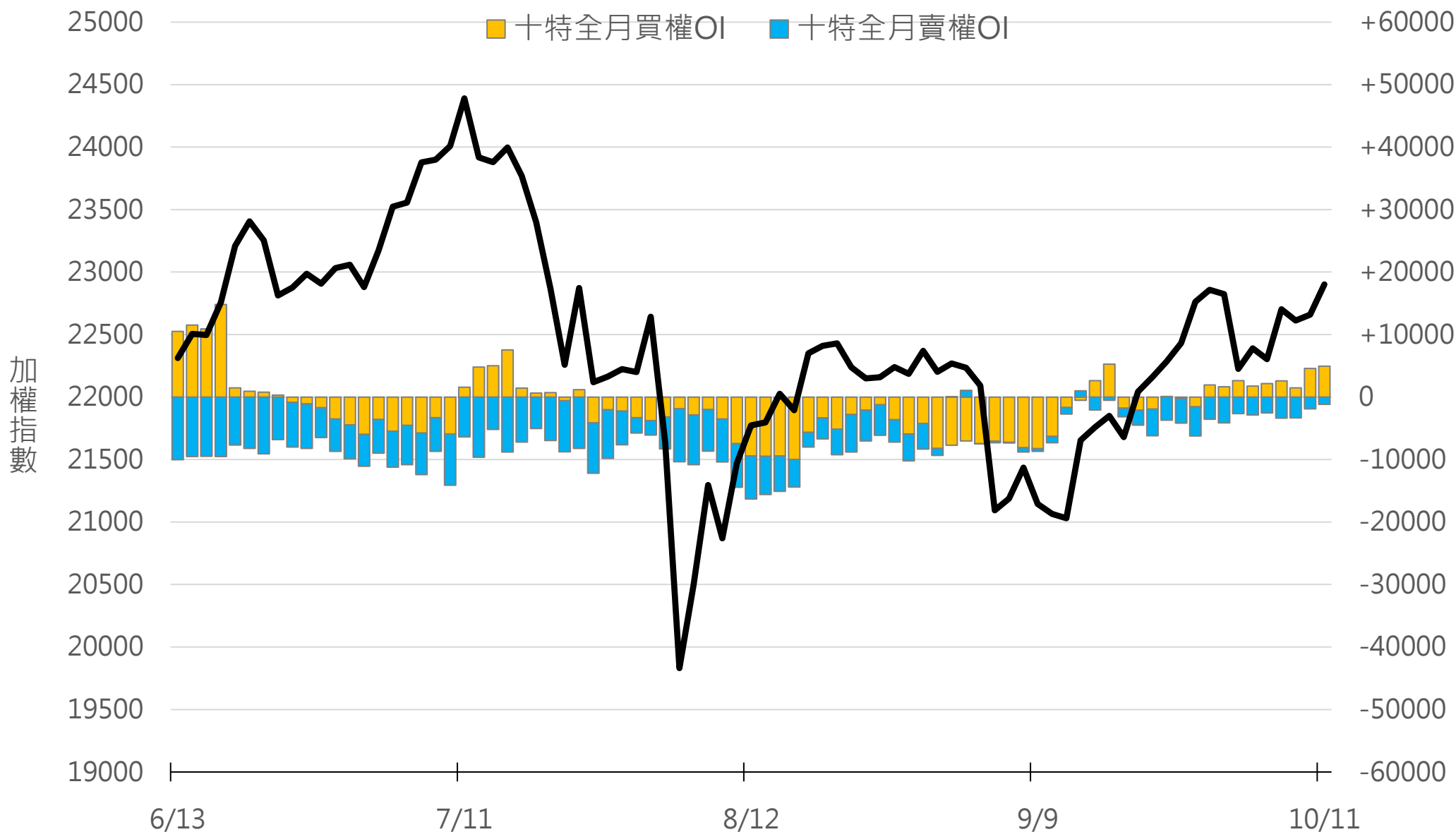


# 十特近月選權OI(口)

0軸以上為買方  
0軸以下為賣方

買權  
賣權

+4950  
-1176

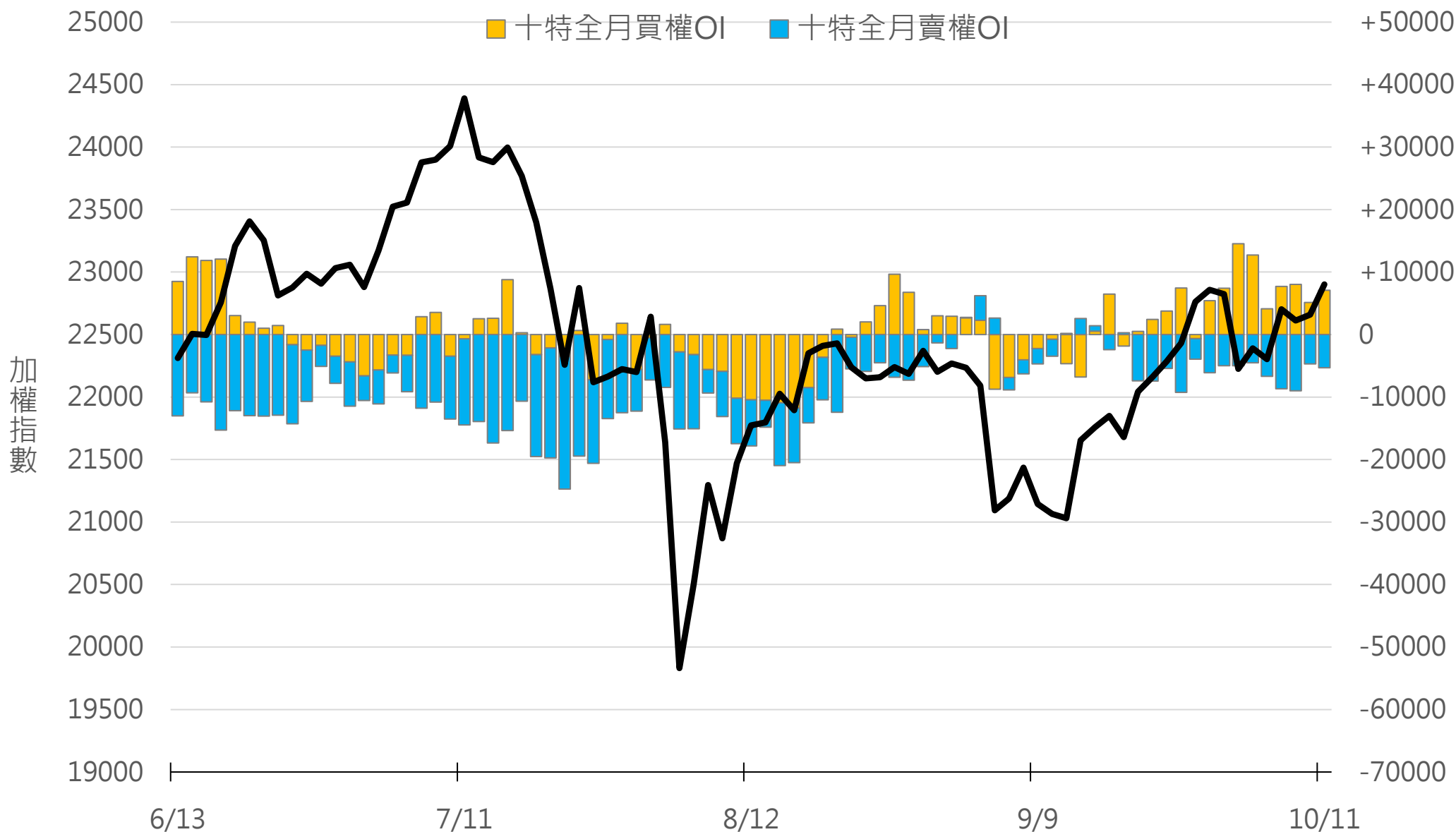


# 十特全月選權OI(口)

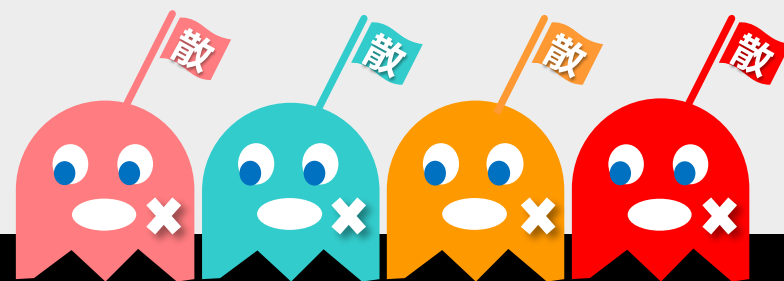
0軸以上為買方  
0軸以下為賣方

買權  
賣權

+7086  
-5302



# 台指期盤後快訊



永豐期貨股份有限公司 | 台北市重慶南路一段2號8樓 | 02-2381-1799 | 111年金管期總字第007號 | 顧問事業部

本研究報告純屬研究性質僅供參考，不保證其完整性及精確性，報告內容具時效性，邇後若有變更，本公司將不做預告或主動更新。交易人決策時應衡量自身需求與交易風險，並就交易結果自行負責，本公司恕不負任何法律責任，亦不作任何保證。未經授權，禁止任何形式抄襲、引用或轉載。